

第九届全国期货实盘大赛比赛规则

- 参赛选手报名时间：2015 年 3 月 16 日—9 月 24 日。
- 正 式 比 赛 时 间：2015 年 3 月 27 日—9 月 25 日。
- 本届大赛为期货实盘账户交易比赛，参赛者自行交易，自负盈亏，一切交易均须遵守《期货交易管理条例》和相关管理办法、期货交易所交易规则及指定交易商（期货公司）的相关管理规定。
- 本届大赛组委会由《期货日报》及大赛指定交易商等单位的有关负责人共同组成；期货交易所有关业务部门应邀组成本次大赛的“三公”审核委员会。
- 指定交易商是作为本次大赛协办方的期货公司，参赛者必须通过指定交易商处报名、参赛。账户报名后权益没有达到相关比赛组的门槛的，不计算成绩，账户权益一旦达到相关比赛组门槛，则在第二个交易日开始计算成绩。

分组设置及组别规则

- 本届大赛最低参赛门槛不低于 1 万元（含持仓）人民币，根据参赛者的期初权益大小以及交易模式分为四个小组分别进行比赛。四个小组分别为：轻量组、重量组、基金组、程序化组，四个小组资金门槛如下：

组别	资金门槛
轻量组	1 万（含）-100 万
重量组	100 万（含）-500 万
基金组	500 万（含）以上
程序化组	5 万（含）以上

● 轻量组、重量组、基金组按照期初权益大小自动分组；程序化组需要在报名时特别说明。

● 比赛期间所有参赛账户均可以自由出入金，但出金后的当日权益低于所在小组的参赛门槛，按“降组”处理，出金后根据当日权益多少自动归入相应小组进行比赛，成绩继续保留。但出金后的当日权益低于 1 万元则按退赛处理，成绩作废。

● 当比赛期间参赛者通过入金或者盈利，使得当日权益达到更高一级小组参赛门槛，则不进行“升组”处理，如果参赛者要求“升组”，则按重新参赛处理，之前成绩作废。

● 单位累计净值小于 1.1，不得参加本届大赛任何奖项的评定。比赛结束后，轻量组单位累计净值大于等于 1.5 的账户、其他组大于等于 1.2 的账户，均可申请获得“业绩鉴定”证书。

● 比赛期间主动提出退赛的参赛者，其成绩作废，不能参加各奖项最终排名。

● “操作指导”一经确定不许更改，不允许中途撤掉或者更换，如实际情况的确需要更改操作指导，则需要提供情况说明，由大赛组委会讨论决定是否更改。

● 一个参赛者在一個比赛组中只允许有一个账户进行比赛（包括操作指导），如果发现同一个参赛者有多个账户在同一个组参赛或者以操作指导名义出现，则大赛组委会有权对其多个账户的成绩进行平均处理或者取最小成绩作为排名依据。

● 比赛最后一天，参赛者可以继续保留持仓，但当日权益按照

收盘价进行计算排名。

● 为保证比赛成绩的公正，参赛者的交易、比赛成绩需接受大赛组委会、审核委员会及整个市场的审核监督。

● 比赛成绩每日在《期货日报》以及期货日报网站公布，比赛最终结果于比赛结束后 5 个交易日之内在《期货日报》以及期货日报网站公布。大赛组委会会把获奖选手信息通知指定交易商，指定交易商负责通知到各自名下的获奖选手的最终成绩以及颁奖盛典的时间地点。

● 大赛审核委员会确定参赛选手有舞弊行为的，取消其参赛资格；发现指定交易商有舞弊行为的，取消其指定交易商资格并在《期货日报》公示，该指定交易商名下的参赛者亦全部取消参赛资格，由此产生的后果由该公司承担。

奖项设置以及排名方法

● 分组奖项

组别	资金要求	冠亚季军奖项（税前）	第 4-10（税前）
轻量组	1 万（含）-100 万	10 万、5 万、3 万、奖杯、证书	5000 元奖品、证书
重量组	100 万（含）-500 万	10 万、5 万、3 万、奖杯、证书	5000 元奖品、证书
基金组	500 万（含）以上	10 万、5 万、3 万、奖杯、证书	5000 元奖品、证书
程序化组	5 万（含）以上	10 万、5 万、3 万、奖杯、证书	5000 元奖品、证书

● 各组排名方法

组别	排名方式	计算方法
轻量组	综合分值最高	综合分=单位累计净值得分*70%+回撤率得分*10%+累计净利润得分*20%
重量组	综合分值最高	综合分=单位累计净值得分*60%+回撤率得分*15%+累计净利润得分*25%
基金组	综合分值最高	综合分=单位累计净值得分*50%+回撤率得分*20%+累计净利润得分*30%
程序化组	综合分值最高	综合分=单位累计净值得分*50%+回撤率得分*20%+累计净利润得分*30%

●资产管理奖

奖项	若干名	排名方式
最佳资产管理奖	奖杯、证书	参与该奖项排名的账户包括：期货公司资管账户、阳光私募账户、基金专户、信托账户。参与账户必须有公开渠道可以查询的估值。该组排名通过公开渠道显示的净值进行计算统计后排名，同时可以展示产品累计净值。该奖项排名以比赛期间净值排名以及产品规模、累计净值进行综合评比。

●单项奖

单项奖	第 1-3 名
最大收益额奖	奖杯、证书
最佳金融期货交易奖	奖杯、证书
最佳有色金属交易奖	奖杯、证书
最佳贵金属交易奖	奖杯、证书
最佳农产品交易奖	奖杯、证书
最佳能源化工交易奖	奖杯、证书
最佳股票期权交易奖	奖杯、证书
最佳商品期权交易奖（预留）	奖杯、证书

●单项奖排名方法

单项奖	排名方式
最大收益额奖	所有参赛账户中累计净利润从高到低排序，且单位累计净值大于等于 1.1
最佳金融期货交易奖	所有参赛账户中交易相关品种的账户中，单位累计净值从高到低排序，单位累计净值大于等于 1.1
最佳有色金属交易奖	
最佳贵金属交易奖	
最佳农产品交易奖	
最佳能源化工交易奖	
最佳股票期权交易奖	在所有通过期货保证金账户交易股票期权（包括 ETF 期权）的账户中选取，单独统计期权交易的收益情况，从高到低进行排名。参与排名的账户数量低于 50 个，则不进行评比。
最佳商品期权交易奖（预留）	在所有交易商品期权的账户中选取，单独统计期权交易的收益情况，从高到低进行排名。参与排名的账户数量低于 50 个，则不进行评比。

● 累计净值的计算方法：

$$P=P1*P2*P3.....*Pn$$

其中 P 为累计净值

Pn 为当日净值

Pn 的计算按（当日盈亏-当日手续费）的值分三种情况：

一、（当日盈亏-当日手续费）>0，出金按盘后，入金按盘前：

$$\text{当日净值} = (\text{当日权益} + \text{当日出金}) / (\text{上日权益} + \text{当日入金})$$

二、（当日盈亏-当日手续费）=0，当日净值=1

三、（当日盈亏-当日手续费）<0，这种情况分 4 种算法：

1.（当日权益-当日入金）>0 AND （上日权益-当日出金）>0，

出金按盘前，入金按盘后：

$$\text{当日净值} = (\text{当日权益} - \text{当日入金}) / (\text{上日权益} - \text{当日出金})$$

2.（当日权益-当日入金）>0 AND （上日权益-当日出金）<0，

出金按盘后，入金按盘后：

$$\text{当日净值} = (\text{当日权益} + \text{当日出金} - \text{当日入金}) / (\text{上日权益})$$

3.（当日权益-当日入金）<0 AND （上日权益-当日出金）>0，

出金按盘前，入金按盘前：

$$\text{当日净值} = (\text{当日权益}) / (\text{上日权益} + \text{当日入金} - \text{当日出金})$$

4. 其他情况，出金按盘后，入金按盘前：

$$\text{当日净值} = (\text{当日权益} + \text{当日出金}) / (\text{上日权益} + \text{当日入金})$$

另外，杂项资金均按盘后出入金处理。

● 各项指标得分计算方法：

指标	计算方式
账户单位累计净值得分	$(\text{账户单位累计净值}/\text{该组所有账户最大累计净值} \times 100) \times 50\% + ((n+1 - \text{名次})/n \times 100) \times 50\%$ ，n=计算日的该组的总账户数量，名次=计算日该账户在该组的排名。
最大回撤率得分	$(n+1 - \text{名次})/n \times 100$ ；n=计算日的该组的总账户数量，名次=计算日该账户在该组的排名。
累计盈利额得分	$(\text{账户累计盈利额}/\text{该组所有账户最大累计盈利额} \times 100) \times 50\% + ((n+1 - \text{名次})/n \times 100) \times 50\%$ ，n=计算日的该组的总账户数量，名次=计算日该账户在该组的排名。

● 最大回撤率的计算

历史最大回撤率= max【（历史最大累计净值-当日累计净值）/历史最大累计净值】

● 单项品种分类奖的账户按照比赛期间交易品种自动分类统计，账户交易的品种不能超出相关分类奖所包括的相关品种，具体分类如下：

品种分类	包含品种
金融期货	股指期货、国债期货
有色金属	铜、锌、铝、螺纹钢、线材、铅、铁矿石、硅铁、锰硅、热卷
贵金属	黄金、白银
农产品	小麦、大豆、玉米、棉花、早籼稻、豆粕、菜粕、白糖、豆油、菜籽油、棕榈油、粳稻、两板、鸡蛋、淀粉
能源化工	天胶、塑料、PTA、PVC、焦炭、焦煤、郑醇、玻璃、动力煤、沥青、聚丙烯

● 单项奖账户选取的原则：账户交易的品种不能超出品种分类所包含品种。比如：某账户在比赛期间只交易了铜、铝，则可以参加最佳有色金属交易奖的评选，如果交易了铜、大豆，则不具备参选单项奖的条件。期权除外。

● 比赛期间如遇新品种上市，则根据新品种属性自动添加到相关分类。

风险及免责条款

● 本次大赛主办方将本着公平、公正和认真态度竭力保证大赛的顺利进行，但对于不可抗拒的因素或非主办方所能控制的情况所导致的风险、系统故障或由于网络问题导致的系统故障对参赛者资金量及排名产生的影响不做担保。

● 参赛者必须保护好自己的相关密码，如因密码丢失或被破解所导致的账户被窃造成的损失，大赛举办方不负任何责任。

● 本次大赛由第九届全国期货实盘交易大赛组委会负责运行，大赛的规则以及各项事项由大赛组委会负责解释。大赛组委会对本次大赛拥有最终解释权。

《期货日报》社

第九届全国期货实盘交易大赛组委会

第二届全球衍生品实盘交易大赛组委会